

## ABSTRAK

Banyak faktor yang mempengaruhi tingkat *return* saham syariah, sehingga tujuan dari penelitian untuk menguji pengaruh profitabilitas diukur dengan *return on investment* (ROI), ukuran perusahaan (*size*), *good corporate governance* (GCG) yang diukur dengan kepemilikan manajerial, kepemilikan institusional, dan komite audit terhadap *return* saham syariah.

Jenis penelitian ini adalah penelitian kuantitatif. Sampel yang digunakan adalah perusahaan yang terdaftar di *Jakarta Islamic Index* (JII) selama periode 2013-2017. Teknik pengambilan sampel yang digunakan adalah metode *purposive sampling*, sehingga diperoleh sampel sebanyak 14 perusahaan yang terdaftar secara berturut-turut dari total keseluruhan sebanyak 30 perusahaan. Periode yang digunakan dalam penelitian ini yaitu 5 tahun, sehingga data yang akan diolah berjumlah 60 data. Metode analisis yang digunakan adalah analisis regresi linier berganda menggunakan program SPSS versi 25.

Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa variabel *return on investment*, ukuran perusahaan berpengaruh terhadap *return* saham syariah. Untuk variabel kepemilikan manajerial, kepemilikan institusional dan komite audit tidak berpengaruh terhadap *return* saham syariah.

**Kata kunci:** Profitabilitas, Ukuran Perusahaan, Good Corporate Governance, Return Saham Syariah.

## **ABSTRACT**

There are so many factors which affect syariah shares return. Therefore, this research aimed to examine the effect of profitability, which was measured by Return On Investment (ROI), firm size (SIZE), good corporate governance which was measured by managerial ownership, institutional ownership, and audit committee on the syariah shares return.

The research was quantitative. While, the population was companies which were listed on Jakarta Islamic Index (JII) 2013-2017. Moreover, the data collection technique used purposive sampling. In line with, there were 14 companies was registered in a row out of a total of 30 companies. The period used in this study is five years, so the data to be processed amounts to 60 data. In addition, the data analysis technique used multiple linear regression with SPSS 25.

The research result concluded Return On Investment (ROI) and firm size had affected syariah shares return. On the other hand, managerial ownership, institutional ownership, and audit committee did not affect syariah shares return.

**Keywords :** Profitability, Firm Size, Good Corporate Governance, Syariah Shares Return.

